

31.03.2023

grundbesitz europa

Liquiditätskennzahlen



Allgemeine Fondsdaten

Anteilklasse RC: WKN 980700 / Anteilklasse IC: WKN A0NDW8

Fondskennzahlen Anteilklasse RC

	März 23 in Mio. EUR	Geschäftsjahr 2022/ 2023 Oktober 22 – März 23 in Mio. EUR	Letzte 12 Monate April 22 – März 23 in Mio. EUR
Mietertrag inklusive Beteiligungsergebnis	26,8	179,8	338,4
Bewirtschaftungsaufwand	-6,4	-45,8	-150,2
Sonstige Erträge/ Aufwendungen	6,2	64,7	213,1
Immobilienergebnis vor Bewertung, Zinsen und Steuern	26,6	198,7	401,3
Wertänderungen und Mehrerlös aus Verkäufen	-24,8	-110,7	2,9
Währungsänderungen	-0,8	-12,4	1,7
Immobilienergebnis vor Zinsen und Steuern	1,0	75,6	405,8
Zinsaufwand	-2,2	-10,7	-19,1
Steuern	-2,1	-12,3	-23,3
Immobilienergebnis	-3,3	52,6	363,4
Erträge aus Liquidität	4,7	34,2	-54,1
Ergebnis gesamter Fonds (vor Abzug der Fondskosten)	1,4	86,8	309,4
Fondskosten	-7,7	-45,8	-99,5
Ergebnis gesamter Fonds (nach Abzug der Fondskosten)	-6,3	41,0	209,9

Ergänzende Fondsdaten Anteilklasse RC

	in Mio. EUR	in Mio. EUR	in Mio. EUR
Durchschnittliches Immobilienvermögen (Verkehrswerte)	9.109,2	9.100,0	9.061,2
Durchschnittliches Immobilienvermögen nach Abzug von Fremdmitteln	7.604,4	7.732,1	7.642,6
Fremdkapitalquote ¹	18,0 %	18,0 %	18,0 %
Durchschnittliches Liquiditätsvermögen	1.251,0	1.249,3	1.353,0
Durchschnittliches Fondsvermögen	8.855,4	8.981,4	8.995,6

Fondskennzahlen Anteilklasse IC

	März 23 in Mio. EUR	Geschäftsjahr 2022/ 2023 Oktober 22 – März 23 in Mio. EUR	Letzte 12 Monate April 22 – März 23 in Mio. EUR
Mietertrag inklusive Beteiligungsergebnis	2,2	15,0	28,3
Bewirtschaftungsaufwand	-0,5	-3,8	-12,6
Sonstige Erträge/ Aufwendungen	0,5	5,4	17,8
Immobilienergebnis vor Bewertung, Zinsen und Steuern	2,2	16,5	33,6
Wertänderungen und Mehrerlös aus Verkäufen	-2,1	-9,2	0,2
Währungsänderungen	-0,1	-1,0	0,1
Immobilienergebnis vor Zinsen und Steuern	0,1	6,3	34,0
Zinsaufwand	-0,2	-0,9	-1,6
Steuern	-0,2	-1,0	-2,0
Immobilienergebnis	-0,3	4,4	30,4
Erträge aus Liquidität	0,4	2,8	-4,5
Ergebnis gesamter Fonds (vor Abzug der Fondskosten)	0,1	7,2	25,9
Fondsgebühren auf Immobilien	-0,4	-2,1	-4,3
Fondsgebühren auf Liquidität	0,0	0,0	-0,1
Sonstige Fondskosten	0,0	-0,1	-0,1
Ergebnis gesamter Fonds (nach Abzug der Fondskosten)	-0,3	5,0	21,5

Ergänzende Fondsdaten Anteilklasse IC

	in Mio. EUR	in Mio. EUR	in Mio. EUR
Durchschnittliches Immobilienvermögen (Verkehrswerte)	754,7	757,0	758,7
Durchschnittliches Immobilienvermögen nach Abzug von Fremdmitteln	630,0	643,2	639,9
Fremdkapitalquote ¹	18,0 %	18,0 %	18,0 %
Durchschnittliches Liquiditätsvermögen	103,6	103,9	113,3
Durchschnittliches Fondsvermögen	733,7	747,1	753,2

¹ Bezugsgröße ist das durchschnittliche Immobilienvermögen nach Verkehrswerten.

Zusätzliche Informationen zum Liquiditätsportfolio

Liquiditätsanlagen	1.326,1 Mio. EUR	
- davon Sichteinlagen	145,2 Mio. EUR	10,95 %
- davon Termineinlagen	214,0 Mio. EUR	16,14 %
- davon Wertpapiere	966,9 Mio. EUR	72,91 %
- davon Aktien	0,0 Mio. EUR	0,00 %
Duration	1,89 Jahre	ohne Sichteinlagen
Wertpapierbestand		
Stresstests (+130 / -190bp)	-2,30 % / +3,70 %	für das Rentenportfolio
Stresstests (+200 / -200bp)	-3,45 % / +3,90 %	für das Rentenportfolio
Durchschnittliche Rendite	4,06 %	für das Rentenportfolio
Durchschnittlicher Kupon	1,44 %	für das Rentenportfolio
Emmittenten		
- Währung	Euro	
- Bonität	mind. Investmentgrade (BBB) oder/und börsengehandeltes Wertpapier	soweit Rating vorhanden
- Unternehmensanleihen	Ja	
- Hybridanleihen	Ja	
- Pfandbriefe / covered bonds	Ja	
ABS-Strukturen	Nein	

Zusätzliche Informationen zur Finanzierung

	Kreditvol. (direkt) in Mio. EUR	in % der Verkehrswerte gesamt	Kredite über Beteiligungs- gesellschaften in Mio. EUR	in % der Verkehrs- werte gesamt	Zinsbindungsrestlaufzeiten des Kreditvolumens in %			Ø-Zinssatz in %
					unter 1 Jahr	1 - 5 Jahre	5 - 10 Jahre	
Euro-Kredite (Ausland)	417,8	4,2	130,7	1,3	3,7	24,0	2,7	1,8
Euro-Kredite (Inland)	305,0	3,1	206,2	2,1	1,7	18,5	8,1	2,0
GBP	436,9	4,4	253,3	2,6	5,2	13,2	19,9	2,4
SEK			55,7	0,6		3,1		1,6
Gesamt	1.159,7	11,8	645,8	6,6	10,6	58,7	30,7	

Risikokennziffer² für die Anteilklasse RC

Konfidenzniveau	1 Tag	10 Tage	3 Monate	1 Jahr	2 Jahre
95,00 %	0,0559 %	0,1769 %	0,4439 %	0,8843 %	1,2506 %
97,50 %	0,0666 %	0,2107 %	0,5290 %	1,0537 %	1,4902 %
99,00 %	0,0791 %	0,2501 %	0,6278 %	1,2507 %	1,7687 %
99,90 %	0,1051 %	0,3323 %	0,8340 %	1,6613 %	2,3495 %

Risikokennziffer² für die Anteilklasse IC

Konfidenzniveau	1 Tag	10 Tage	3 Monate	1 Jahr	2 Jahre
95,00%	0,0551 %	0,1741 %	0,4370 %	0,8706 %	1,2312 %
97,50%	0,0656 %	0,2075 %	0,5208 %	1,0374 %	1,4671 %
99,00%	0,0779 %	0,2462 %	0,6181 %	1,2312 %	1,7412 %
99,90%	0,1034 %	0,3271 %	0,8210 %	1,6355 %	2,3130 %

² Kennzahl für Investmentfonds zum Zwecke der Verwendung für Risiko-Messsysteme bei Kreditinstituten im Rahmen der MaRisk ([Standard-Abweichung (Fondsreturns der letzten 60 Tage) multipliziert mit Normierungsfaktor])

Solvabilitätskennziffer³: 115,16 %

Fremdwährungsanteil am Fondsvermögen⁴: 14,46 %
davon ungesichert: 2,33 %

³ Gemäß Artikel 132 Abs. 5 Satz 3 CRR, SolvV

⁴ Gemäß Artikel 353 Abs. 2 Satz 2 CRR, SolvV

Volatilität

Anteilklasse	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre
RC	0,51 %	0,53 %	0,83 %	0,68 %	0,62 %	0,58 %
IC	0,49 %	0,52 %	0,84 %	0,69 %	0,63 %	0,59 %

Wertpapierbestand

WKN/ ISIN	Wertpapierbezeichnung/ Emittent	Stücke/ Nominale	Effek- tenkurs	Kurswert	Wert- papier- art	Rating Moody's	Rating S+P	Coupon	Fälligkeit	Floa- ter
XS2010039035	Deutsche Bahn Fin. GmbH	30.400.000 €	92,75 %	28.196.000 €	UA	Baa1	BBB-	0,95 %	22.01.2025	nein
DE000A289XH6	Daimler AG	11.000.000 €	99,46 %	10.940.600 €	UA	A2	A-	1,63 %	22.08.2023	nein
XS2207430120	Tennet Holding BV	6.500.000 €	93,42 %	6.072.040 €	UA	Baa3	BB+	2,37 %	22.07.2025	nein
XS2225157424	Vodafone Group PLC	7.000.000 €	89,88 %	6.291.880 €	UA	Ba1	BB+	2,63 %	27.08.2026	nein
DE000HC80AX8	Hamburg Commercial Bank	75.000.000 €	97,46 %	73.095.000 €	FiA	Baa2		0,35 %	08.01.2024	nein
XS1591694481	Tennet Holding BV	5.000.000 €	98,41 %	4.920.400 €	UA	Baa3	BB+	3,00 %	01.03.2024	nein
XS2293755125	Republic of Iceland	12.788.000 €	84,37 %	10.789.427 €	St A	A2	A	0,01 %	15.04.2028	nein
DE000HC80AZ3	Hamburg Commercial Bank	50.000.000 €	87,14 %	43.570.000 €	FiA	A3		0,38 %	09.03.2026	nein
DE0001141802	Bundesobligation	15.000.000 €	96,03 %	14.404.315 €	StA	Aaa		0,01 %	18.10.2024	nein
FR0014001N38	France, Republic of (Government)	2.857.525 €	99,14 %	2.833.036 €	StA	Aa2	AA	0,10 %	25.07.2031	nein
DE000DB7XKH4	Deutsche Bank AG	10.000.000 €	94,73 %	9.472.500 €	FiA	A2	BBB+	3,84 %	30.07.2025	nein
XS1440586581	Deutsche Bank AG	10.000.000 €	89,52 %	8.951.850 €	FiA	Baa1		4,51 %	30.06.2031	nein
XS2187689034	Volkswagen Int. Fin.	6.800.000 €	94,41 %	6.419.608 €	UA	Baa2	BBB-	3,50 %	17.06.2025	nein
XS2381261424	Münchener Rückversicherung	11.000.000 €	70,10 %	7.710.679 €	UA		A	1,00 %	26.11.2031	nein
ES0000012C12	Spanien	1.117.162 €	96,93 %	1.082.809 €	StA	Baa1		0,70 %	30.11.2033	nein
FR0014005EJ6	Danone SA	11.500.000 €	85,99 %	9.888.697 €	UA	Baa3	BBB-	1,00 %	16.09.2026	nein
XS2244941147	Iberdrola International BV	5.000.000 €	81,66 %	4.082.944 €	UA		BBB-	2,25 %	28.01.2029	nein
DE000HC80A86	Hamburg Commercial Bank	23.000.000 €	88,03 %	20.246.900 €	FiA	Baa2		0,50 %	22.09.2026	nein
NL0000120889	Aegon NV	8.605.000 €	29,40 %	2.529.496 €	UA	Baa1		0,50 %	04.03.2031	nein
FR0014006144	Groupe ACM (Groupe des Assurances du Credit Mutuel)	10.000.000 €	72,25 %	7.224.631 €	FiA	Baa1		1,85 %	21.04.2042	nein
XS2408458227	Deutsche Lufthansa AG	12.000.000 €	98,24 %	11.788.560 €	UA	Ba2	BB	1,63 %	16.11.2023	nein
XS2411178630	Bayerische Landesbank	10.000.000 €	79,34 %	7.934.470 €	FiA	Baa2		1,38 %	22.11.2032	nein
FR0014006XE5	Banque Federative du Credit Mutuel	43.800.000 €	93,19 %	40.817.313 €	FiA	Aa3	A+	0,01 %	07.03.2025	nein
XS2187689380	Volkswagen Int. Fin.	13.000.000 €	85,73 %	11.144.299 €	UA	Baa2	BBB-	3,88 %	17.06.2029	nein
XS2218405772	Merck KGAA	10.700.000 €	88,44 %	9.462.705 €	UA	Baa2	BBB+	1,63 %	09.06.2026	nein
XS0181369454	AXA S.A.	5.600.000 €	79,15 %	4.432.400 €	UA		A-	3,43 %	02.03.2022	nein
XS2436160779	Banco Santander SA	12.600.000 €	96,95 %	12.215.574 €	UA	A2	A+	0,10 %	26.01.2025	nein
XS2010039548	Deutsche Bahn Fin. GmbH	10.000.000 €	79,86 %	7.985.600 €	UA	Baa1	BBB-	1,60 %	18.07.2029	nein
XS0203470157	AXA S.A.	5.000.000 €	80,84 %	4.042.050 €	UA	A3	A-	3,08 %	29.12.2049	nein
XS2463505581	E.ON SE	10.500.000 €	95,70 %	10.049.003 €	UA	Baa2	BBB	0,88 %	08.01.2025	nein
XS2463974571	ABB Finance	5.000.000 €	97,29 %	4.864.682 €	UA	A3	A-	0,63 %	31.03.2024	nein
XS2441244535	NOVO NORDISK FINANCE NL	5.000.000 €	95,07 %	4.753.548 €	UA		AA-	0,75 %	31.03.2025	nein
DE000A289N78	Deutsche Börse	10.000.000 €	87,64 %	8.763.875 €	UA		A+	1,25 %	16.03.2027	nein
XS2342732646	Volkswagen Int. Fin.	10.000.000 €	83,65 %	8.365.400 €	UA	Baa2	BBB-	4,38 %	28.03.2031	nein
XS2152058868	Volkswagen Int. Fin.	2.000.000 €	99,98 %	1.999.580 €	UA	A3	BBB+	2,50 %	06.04.2023	nein
XS1893631330	Volkswagen Int. Fin.	3.192.000 €	98,98 %	3.159.442 €	UA	A3	BBB+	1,38 %	16.10.2023	nein
XS2342732562	Volkswagen Int. Fin.	7.500.000 €	88,48 %	6.635.663 €	UA	Baa2	BBB-	3,75 %	28.12.2027	nein
FR0012173862	Pernod Ricard SA	10.000.000 €	98,24 %	9.823.714 €	UA	Baa1	BBB+	2,13 %	27.09.2024	nein
XS2343821794	Volkswagen Leasing GmbH	15.000.000 €	95,58 %	14.337.645 €	UA	A3	BBB+	0,01 %	19.07.2024	nein
XS2482872418	Fresenius SE & Co KGaA	10.000.000 €	96,55 %	9.655.052 €	UA	Baa3	BBB	1,88 %	24.05.2025	nein
FR0013397320	Credit Mutuel Arkea SA	15.600.000 €	95,58 %	14.910.606 €	FiA	Aa3	NR	1,38 %	17.01.2025	nein
XS1014610254	Volkswagen Leasing GmbH	5.000.000 €	99,36 %	4.968.200 €	UA	A3	BBB+	2,63 %	15.01.2024	nein
XS1865186677	Volkswagen Leasing GmbH	10.000.000 €	95,90 %	9.590.011 €	UA	A3	BBB+	1,63 %	15.08.2025	nein
XS2314246526	Stedin Holding NV	4.000.000 €	83,95 %	3.357.800 €	UA		BBB-	1,50 %	31.12.2026	nein
DE000DL19VD6	Deutsche Bank AG	10.000.000 €	93,72 %	9.372.014 €	FiA	A1	A-	1,38 %	10.06.2026	nein
DE000DL19VS4	Deutsche Bank AG	10.000.000 €	77,54 %	7.754.330 €	FiA	Baa1	BBB-	1,75 %	19.11.2030	nein
XS1629774230	Volkswagen Int. Fin.	10.000.000 €	90,24 %	9.023.663 €	UA	Baa2	BBB-	3,88 %	14.06.2027	nein
DE000BHY0GK6	Berlin Hyp AG	15.000.000 €	95,79 %	14.369.139 €	FiA	Aaa		1,25 %	25.08.2025	nein
XS2554997937	Covestro AG	7.000.000 €	101,44 %	7.100.658 €	UA	Baa2		4,75 %	15.11.2028	nein
XS2563353361	Orsted A/S	3.000.000 €	98,72 %	2.961.713 €	UA	Baa3	BB+	5,25 %	08.09.2028	nein
XS2443749648	Telia Company AB	3.000.000 €	88,09 %	2.642.745 €	UA	Baa3	BBB-	2,75 %	30.03.2028	nein
XS2293060658	Telefonica Europa BV	3.000.000 €	78,59 %	2.357.670 €	UA	Ba2	BB	2,38 %	11.05.2029	nein
XS2575952424	Banco Santander SA	20.000.000 €	99,82 %	19.964.678 €	FiA	A2	A+	3,75 %	16.01.2026	nein
XS2576550086	Enel Spa	5.000.000 €	100,57 %	5.028.538 €	UA	Baa3	BBB-	6,38 %	16.07.2028	nein
XS2576550243	Enel Spa	3.000.000 €	100,84 %	3.025.313 €	UA	Baa3	BBB-	6,63 %	16.07.2031	nein
XS2580221658	Iberdrola Finanzas SAU	11.500.000 €	96,70 %	11.120.558 €	UA	Baa3	BBB-	4,88 %	25.01.2030	nein
EU000A1G0BC0	European Financial Stability Facility	50.000.000 €	99,88 %	49.940.000 €	FiA	Aaa	AA	1,88 %	23.05.2023	nein

31.03.2023

grundbesitz europa

Liquiditätskennzahlen



Wertpapierbestand

WKN/ ISIN	Wertpapierbezeichnung/ Emittent	Stücke/ Nominale	Effek- tenkurs	Kurswert	Wert- papier- art	Rating Moody's	Rating S+P	Coupon	Fälligkeit	Floa- ter
XS2552369469	Red Electrica Corporacion S.A.	3.000.000 €	99,01 %	2.970.250 €	UA		BBB	4,63 %	07.05.2028	nein
DE000BU0E006	BU Bill (unverzinsl. Schatzanweisung)	50.000.000 €	98,02 %	49.009.500 €	StA	Aaa		0,00 %	13.12.2023	nein
XS2225204010	Vodafone Group PLC	3.000.000 €	80,85 %	2.425.500 €	UA	Ba1	BB+	3,00 %	27.08.2030	nein
XS2587352340	General Motors Financial Company INC	9.000.000 €	98,74 %	8.886.435 €	UA		BBB	4,30 %	15.02.2029	nein
XS2588099981	Svenska Handelsbanken AB	15.000.000 €	98,44 %	14.766.150 €	FIA	Aa2	AA-	3,38 %	17.02.2028	nein
XS2477935345	Tennet Holding BV	10.000.000 €	95,77 %	9.576.704 €	UA		A-	1,63 %	17.11.2026	nein
EU000A3K4D33	EU TBILL	55.000.000 €	98,70 %	54.285.000 €	StA	Aaa	AA+	0,00 %	08.09.2023	nein
DE000BU0E022	Bundesrepublik Deutschland TBill	50.000.000 €	97,46 %	48.727.500 €	StA	Aaa		0,00 %	21.02.2024	nein
XS2599730822	Heineken NV	8.700.000 €	101,67 %	8.845.145 €	UA	A3	BBB+	3,88 %	23.09.2030	nein
DE0001030864	BU TBILL	100.000.000 €	99,22 %	99.220.000 €	StA	Aaa		0,00 %	19.07.2023	nein
ES0000012L52	Spanien	20.000.000 €	98,70 %	19.740.700 €	StA	Baa1	A	3,15 %	30.04.2033	nein
	Summe			966.893.902 €				Ø Coupon, gewichtet nach Kurswert	1,38 %	

31.03.2023

grundbesitz europa

Liquiditätskennzahlen



Liquiditätsanlagen

Liquiditätsanlagen - gegliedert nach Laufzeitbändern	Tages-/ Termingeld- anlagen in EUR	Anleihen in EUR	Futures in EUR	Gesamt in EUR
bis 1 Monat	33.216.552	6.431.980	0	39.648.532
1 bis 3 Monate	10.134.458	49.940.000	0	60.074.458
3 bis 6 Monate	146.641.846	164.445.600	0	311.087.446
6 bis 12 Monate	24.002.663	195.668.602	0	219.671.264
1 bis 2 Jahre	0	149.618.852	0	149.618.852
2 bis 3 Jahre	0	123.866.576	0	123.866.576
3 bis 4 Jahre	0	76.960.574	0	76.960.574
4 bis 5 Jahre	0	30.425.475	0	30.425.475
5 bis 7 Jahre	0	77.070.836	0	77.070.836
7 bis 10 Jahre	0	60.375.218	0	60.375.218
10 bis 15 Jahre	0	20.823.509	0	20.823.509
15 bis 20 Jahre	0	7.224.631	0	7.224.631
Über 20 Jahre	0	4.042.050	0	4.042.050
Liquiditätsanlagen (ohne Sichteinlagen) in EUR:	213.995.519	966.893.902		1.180.889.420
Sichteinlagen/ Aktien in EUR:				145.184.169
Liquiditätsanlagen in EUR:				1.326.073.590

Durchschnittliche Modified Duration: 1,89

(Gewichtete, durchschnittliche Anlagedauer in Jahren, ermittelt auf Grundlage der geschätzten Modified Duration je Laufzeitband lt. BaFin Rundschreiben 7/2007)

DWS Grundbesitz GmbH

Mainzer Landstraße 11-17
60329 Frankfurt am Main
realassets.dws.com

Wichtige Hinweise

DWS ist der Markenname, unter dem die DWS Group GmbH & Co. KGaA und ihre Tochtergesellschaften ihre Geschäfte betreiben. Die jeweils verantwortlichen rechtlichen Einheiten, die Kunden Produkte oder Dienstleistungen der DWS anbieten, werden in den entsprechenden Verträgen, Verkaufsunterlagen oder sonstigen Produktinformationen benannt.

Der Fonds grundbesitz europa ist ein von der DWS Grundbesitz GmbH aufgelegtes und von ihr verwaltetes Sondervermögen i. S. des Kapitalanlagegesetzesbuches (KAGB).

Die vorstehende Kurzinformation stellt keine Anlageberatung dar, sondern dient lediglich der auszugswweisen Produktbeschreibung. Eine Anlageentscheidung sollte in jedem Fall auf Grundlage des Basisinformationsblattes und des Verkaufsprospekts, ergänzt durch den jeweiligen letzten geprüften Jahresbericht und zusätzlich durch den jeweiligen Halbjahresbericht, falls ein solcher jüngeren Datums als der letzte Jahresbericht vorliegt, getroffen werden. Diese Unterlagen stellen die allein verbindliche Grundlage des Kaufs dar. Die Unterlagen erhalten Sie in deutscher Sprache in gedruckter Form kostenlos bei Ihrem Finanzberater, in den Geschäftsstellen der Deutsche Bank AG und der DWS Investment GmbH, 60612 Frankfurt am Main (letztere erbringt für die DWS Grundbesitz GmbH vertriebsunterstützende Dienstleistungen) sowie in elektronischer Form unter realassets.dws.com. Der Verkaufsprospekt enthält ausführliche Risikohinweise.

Eine zusammenfassende Darstellung der Anlegerrechte für Anleger ist in deutscher Sprache in elektronischer Form unter realassets.dws.com/footer/rechtliche-hinweise/ verfügbar.

Dieser Fonds nimmt entsprechend der gesetzlichen Regelungen (Artikel 8 der EU-Offenlegungsverordnung (EU) 2019/2088) eine Offenlegung im Hinblick auf ökologische Merkmale, die er berücksichtigt, vor. Weitere Informationen zur Offenlegungsverordnung des Fonds finden Sie unter realassets.dws.com/ und im aktuellen Verkaufsprospekt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann beschließen, den Vertrieb jederzeit zu widerrufen.

Die Fondskennzahlen und ergänzende Fondsdaten sind bis zum 30.9.2022 durch einen Wirtschaftsprüfer geprüft. Die Kennzahlen ab dem 1.10.2022 sind vorläufig.

Die DWS Grundbesitz GmbH übernimmt für die Richtigkeit dieser Kennzahlen keine Gewähr.
©DWS Grundbesitz GmbH